

**AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS**

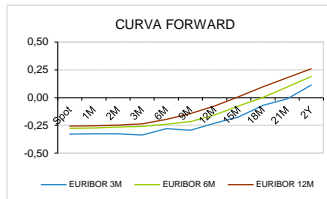
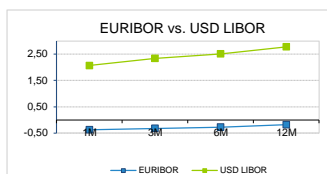
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

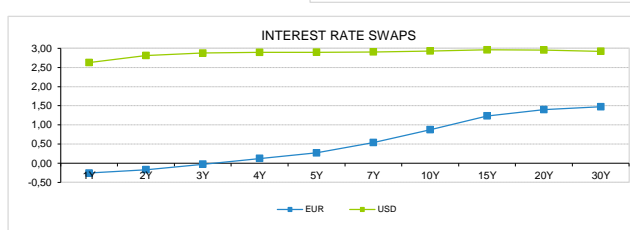
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0665	-1	2	0,5409	-0,7762
3M	-0,3210	0	0	3M	2,3374	0	1	0,7199	-0,7306
6M	-0,2710	0	0	6M	2,5119	0	2	0,8331	-0,6470
12M	-0,1790	0	0	12M	2,7809	1	4	1,0008	-0,5184

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2573	0	-2	-0,0760	0,5820	1,1150
2Y	-0,1690	0	-5	0,0918	0,7238	1,2275
3Y	-0,0260	0	-7	0,2555	0,8540	1,3310
4Y	0,1250	0	-9	0,4070	0,9740	1,4220
5Y	0,2710	0	-10	0,5464	1,0845	1,5090
7Y	0,5410	0	-11	0,7972	1,2755	1,6425
10Y	0,8770	0	-11	1,0945	1,4791	1,7550
15Y	1,2360	1	-9	1,3815	1,6432	1,8255
20Y	1,4010	1	-8	1,5071	1,6901	1,8049
30Y	1,4730	1	-6	1,5429	1,6642	1,7365

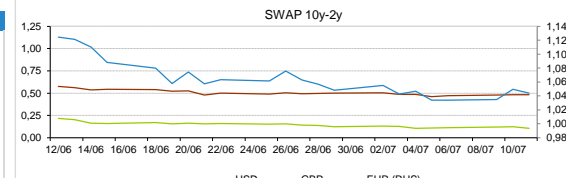
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



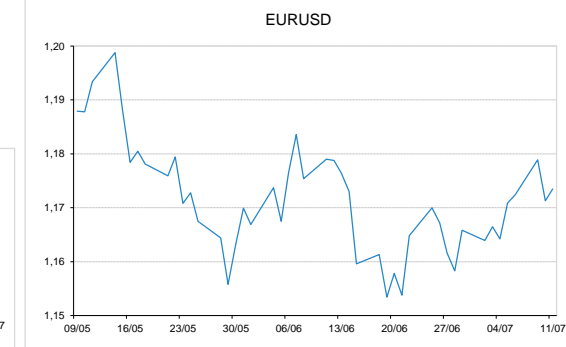
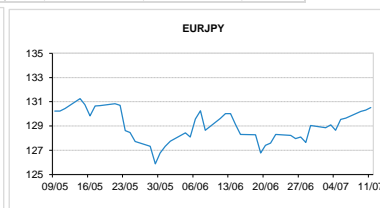
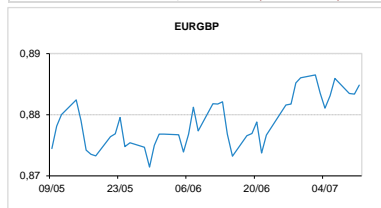
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6250	1	5	3,0112	2,9396	2,8760
2Y	2,8130	1	4	3,0052	2,9000	2,8850
3Y	2,8740	1	2	2,9840	2,8910	2,8990
4Y	2,8910	2	0	2,9469	2,8845	2,9085
5Y	2,8960	2	-2	2,9542	2,8955	2,9660
7Y	2,9040	2	-4	2,9240	2,9512	2,9620
10Y	2,9310	3	-6	2,9510	2,9500	2,9700
15Y	2,9590	3	-8	2,9640	2,9570	2,9530
20Y	2,9560	4	-9	2,9490	2,9240	2,9330
30Y	2,9230	4	-9	2,9315	2,8745	2,8660



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,34	-2,52	0,15	OT 2Y	-0,078	0,02	-4,00
JETFUEL	711,81	-14,52	-0,86	OT 5Y	0,606	0,00	-21,70
DIESEL	668,06	-13,02	-1,61	OT 10Y	1,773	0,02	-22,60
COBRE	6.345,00	-57,50	-979,50	BUND 10Y	-0,190	-1,25	-21,00
ZINCO	2.656,00	-61,00	-554,50	SCHATZ 2Y	-0,007	0,69	-3,20
OURO	1.246,79	-7,70	-53,52	T-NOTE 10Y	3,584	-1,51	-7,90
TRIGO	478,25	-13,75	-52,50	T-NOTE 2Y	2,981	-1,17	2,00
LICENÇA C02	16,32	0,27	0,83	GILT 10Y	1,518	-0,29	-12,20


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1735	0,19%	-0,47%	1,1817	1,1908	1,2098
EUR/GBP	0,88482	-0,16%	-0,34%	0,8874	0,8903	0,8966
EUR/JPY	130,53	-0,18%	-0,70%	130,53	130,53	130,53
EUR/CHF	1,1646	0,02%	-0,22%	1,1634	1,1622	1,1600
EUR/BRL	4,5269	-1,08%	-3,38%	4,5996	4,6720	4,8265
EUR/PLN	4,3363	-0,42%	-1,53%	4,3603	4,3837	4,4321

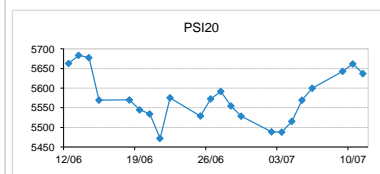

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1735	0,8848	130,53	1,1646	10,2889	7,4545	1,5394	1,58475	4,5269	9,4491
USD	0,8532	-	0,7547	111,28	0,9929	8,7688	6,3599	1,3122	1,3498	3,8444	8,0440

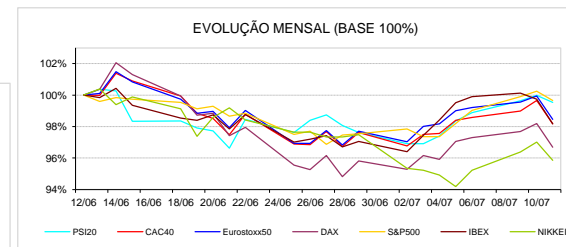
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	9,060	1,00	75,21
BCP	0,258	0,27	-5,11
CORT. AMORIM	11,4200	-1,38	10,87
CTT	2,8900	-1,37	-17,59
EDP	3,505	0,43	21,49
EDP R	9,005	-0,88	29,25
GALP	17,010	-1,48	11,00
IBERSOL	12,050	-2,03	-0,82
J MARTINS	12,710	0,12	-21,52
MOTA ENGIL	3,020	-2,27	-17,55
NAVIGATOR	5,080	-0,39	20,38
NOS	4,944	-0,28	-9,80
NOVABASE	2,710	0,00	-11,12
PHAROL	0,242	-0,41	-3,20
REN	2,456	-0,89	-0,93
SEMAPA	22,800	0,00	28,13
SONAE CAP.	0,932	-0,75	5,07
SONAE SGPS	1,013	-0,98	-10,04

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
ALTRI	1,00
EDP	0,43
BCP	0,27
J MARTINS	0,12
CTT	-1,37
CORT. AMORIM	-1,38
GALP	-1,48
IBERSOL	-2,03
MOTA ENGIL	-2,27



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.636,79	-0,44%	4,61%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.353,93	-1,48%	0,78%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.422,35	-1,47%	-2,33%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.417,13	-1,53%	-3,87%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.776,85	-0,60%	3,87%	2.872,87	2.412,79
IBEX 35	9.733,60	-1,57%	-3,09%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	21.932,21	-1,19%	-3,66%	24.129,34	19.239,52



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.